

# 東京短資デイリーレポート

2023/3/2

## <3月1日のマナリーベース>

6,505,300
-----------

## <3月2日9時20分日銀オペ後の状況>

9時20分の日銀オペ	ノーオペ
日銀発表の日銀当座預金残高	5,248,000
前日の日銀当座預金残高①	5,235,500
日銀当座預金残高増減前日比	+12,500

## <3月2日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

資金需給実績		
銀行券要因		-700
財政等要因		-44,700
資金過不足		-45,400
金融調節		
	期落	新規
CP等買入	-100	
国債補完供給	+51,700	-56,500
金融調節合計		-4,900
当座預金増減②		-50,300

## <3月2日の日銀当座預金状況>

当座預金残高(①+②)	5,185,200
準備預金残高	4,534,100
積み終了先	4,533,800
超過準備	4,533,500
非準備先残高	651,100

## <参考>

今積み期間所要準備額(積数)	3,518,100
今積み期間所要準備額(平均)	125,600
残り要積立額(積数)	1,500
残り要積立額(平均)	100
準備進捗率(%)	99.9
日数進捗率(%)	53.6
進捗率乖離幅	+46.3

## <3月3日の日銀当座預金増減要因と金融調節>

資金需給予想		
銀行券要因		+100
財政等要因		-30,200
資金過不足		-30,100
金融調節確定分		
	期落	新規
国債買入		+17,700
CP等買入	-200	
社債等買入	-800	
国債補完供給	+61,900	
成長基盤強化支援	-2,500	
金融調節合計		+76,100
当座預金増減		+46,000

## <3月3日のオペ予想>

朝一の金融調節はノーオペ (当預残523兆1,200億円)で 無担保コール0/Nは-0.015%~-0.005% での合いが中心か。
---

## <3月3日9時20分のオペによる日銀当座預金状況>

9時20分のオペ	日銀当座預金残高	前日比増減
+45,000	5,276,200	+91,000
+40,000	5,271,200	+86,000
+35,000	5,266,200	+81,000
+30,000	5,261,200	+76,000
+25,000	5,256,200	+71,000
+20,000	5,251,200	+66,000
+15,000	5,246,200	+61,000
+10,000	5,241,200	+56,000
+5,000	5,236,200	+51,000
±0	5,231,200	+46,000
-5,000	5,226,200	+41,000
-10,000	5,221,200	+36,000
-15,000	5,216,200	+31,000
-20,000	5,211,200	+26,000
-25,000	5,206,200	+21,000
-30,000	5,201,200	+16,000
-35,000	5,196,200	+11,000
-40,000	5,191,200	+6,000
-45,000	5,186,200	+1,000

## <3月2日 日銀オペ入札結果>

※スペースの関係上、内容を省略する場合があります。詳細は弊社HPをご参照ください。

(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 3/ 3	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.055%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 3/ 3	応札	17,698億	落札	17,698億	固定利回較差	0.000%
(10:10) 国債買入(国)(5Y-10Y)	23/ 3/ 3	応札	0億	落札	0億	固定利回較差	+0.085%
(11:50) 国債補完供給	23/ 3/ 2-23/ 3/ 3	応札	19,439億	落札	18,854億	全取	-1.100% 平均 -3.423%
(11:50) 国債補完供給	23/ 3/ 2-23/ 3/ 3	応札	37,410億	落札	37,410億	全取	-0.350% 平均 -0.351%
(13:50) 国債補完供給	23/ 3/ 2-23/ 3/ 3	応札	150億	落札	150億	全取	-0.350% 平均 -0.350%
(13:50) 国債補完供給	23/ 3/ 2-23/ 3/ 3	応札	485億	落札	485億	全取	-3.000% 平均 -3.000%

## <3月2日 各オペ残高と内訳>

(カッコ内は先日付スタート・#印はエンドが13時同時処理)

共通担保(全)固定金利	国債買入額(月初来)	貸出増加支援資金供給	貸出増加支援資金供給	被災地金融機関支援資金供給		
9,511	0	成長基盤強化支援資金供給	貸出増加支援資金供給	1,716		
1/ 5~ 1/ 6 10,016.	2/24(5-10Y) 3,004.	55,060	682,240	5/14~ 5/12 300.		
1/ 6~ 1/ 6 20,014.	2/24(10-25Y) 1,004.	3/ 4~ 3/ 3 2,859.	3/18~ 3/17 37,714.	6/11~ 5/12 596.		
1/10~ 1/10 20,011.	2/28(3-5Y) 5,003.	3/ 6~ 3/ 6 1.	6/19~ 6/19 28,033.	8/20~ 8/18 0.		
1/13~ 1/14 20,008.	2/28(5-10Y) 6,755.	6/ 4~ 6/ 2 4,312.	9/17~ 9/15 13,014.	11/19~11/17 0.		
1/16~ 1/16 20,009.	2/28(10-25Y) 3,006.	6/ 5~ 6/ 5 5.	12/16~12/15 20,601.	2/18~ 2/16 0.		
1/19~ 1/20 1,163.	2/28(物国) 601.	9/ 3~ 9/ 1 1,940.		5/17~ 5/17 0.		
2/22~ 3/ 8 4,290.		9/ 4~ 9/ 4 34.		8/19~ 8/19 381.		
		12/ 4~12/ 4 10,258.		11/18~11/18 93.		
		3/ 4~ 3/ 4 2,178.		2/17~ 2/17 346.		
			※直近約1年分の期落ち分を記載			
			米ドル資金供給オペ			
			2百万ドル			
			3/ 2~ 3/ 9 2.			
			※直近約1年分の期落ち分を記載			
			成長基盤強化支援米ドル特別			
			17,925百万ドル			
			3/ 4~ 3/ 3 2,369.			
			6/ 3~ 6/ 2 5,848.			
			9/ 2~ 9/ 5 6,101.			
			12/ 2~12/ 4 3,607.			
			(3/ 3~ 3/ 4 2,153.)			
			国債買入先オペ			
			0			
			国債売現先オペ			
			0			
			※直近約1週間の実施分を記載			
			国債買入額(月初来)			
			0			
			CP買入額(月初来)			
			0			
			社債買入額(月初来)			
			0			
			ETF買入額			
			354,818			
			約定 22/12/ 2 701.			
			ETF買入額(企業支援)			
			14,628			
			約定 21/ 3/31 12.			
			J-REIT買入額			
			6,823			
			約定 22/ 6/14 12.			
			※直近約1週間の実施分を記載			
			成長基盤強化支援資金供給の各オペは、貸付日・返済期日が同じ場合まとめて表示しています。			
			ETF・J-REIT買入は、買入総額と直近の買入を表示しています。共通担保・成長基盤強化支援・貸出増加支援の各資金供給オペの貸付残高は、期日前返済による減少があるため、貸付額の合計とは必ずしも一致しません。			
			共通担保(全)固定	95,511	CP等買入(推定)	26,400
			国債買現先	0	社債等買入(推定)	81,800
			被災地金融機関支援	1,716		
			気候変動対応支援	44,214		
			成長基盤強化支援	50,442		
			貸出増加支援	608,567	手形売出	0
			新型コロナウイルス企業金融支援	89,247	国債売現先	0
			供給オペ合計	889,697	国債補完供給	56,899
			貸出(推定)	0	国債売現先	2
			供給額合計	889,697	吸収額合計	56,901
				差し引き	832,796	

## <3月2日のオープン市場気配レート(単位:%)>

S/N	NCD/CP現先		CPプライマリ		TBアウトライト	
	0.000	1M	1M	-----	3M	買気配 -0.130
1W	売気配 -0.020	2M	-----	6M	買気配 -0.100	
2W	売気配 -0.020	3M	-----	1Y	買気配 -0.030	
1M	売気配 -0.020					

## <3月1日のコール市場残高(単位:億円)>

市場合計	残高		増減
	有担保	無担保	
市場合計	200,667		-2,289
有担保	30,286		+2,820
無担保	170,381		-5,109

## <3月2日のコール市場レート速報と東京レポ・レート(単位:%)>

	無担保コール				有担保コール				東京レポレート	
	最低	最高	平均	前日比	最低	最高	平均	前日比	平均値	前日比
翌日物	-0.057	0.001	-0.011	±0				-----	-0.085	+0.001
トムネ			-0.010	±0				-----	-0.086	±0
スポネ			-0.008	-----				-----		
1週間物				-----				-----	-0.097	±0
2週間物	-0.025	-0.009	-0.020	-0.001				-----	-0.104	-0.001
3週間物			-0.001	-----				-----	-0.115	+0.001
1ヶ月物			-0.018	-----				-----	-0.147	-0.002
3ヶ月物				-----				-----	-0.146	-0.001
6ヶ月物				-----				-----	-0.106	±0
1年物				-----				-----	-0.083	±0

本資料は情報提供を目的としてのみ作成されたものであり、お取引の最終決定は御自身の判断でなされますようお願いいたします。  
本資料に記載されている内容は、信頼できる情報源に基づき作成されたものですが、弊社はその正確性および確実性を保証するものではありません。  
非上場債券(国債、CP等)を当社が相手方となりお買付けいただく場合は、購入対価のみお支払いいただきます。  
債券は、金利水準の変化等により価格が上下し、損失が生じるおそれがあります。  
商号等：東京短資株式会社 登録金融機関 関東財務局長(登金)第524号 加入協会：日本証券業協会